Mysteel 再生精铅 2023 年度自我评估报告

为保证上海钢联电子商务股份有限公司（以下简称“Mysteel”或“上海钢联”）编制的再生精铅价格指数（以下简称“指数”或“价格指数”）符合发改委《重要商品和服务价格指数行为管理办法》（以下简称“《办法》）及公司价格指数管理要求，持续稳定的运行。Mysteel 再生精铅价格指数团队针对 2023 年再生精铅价格指数的行为主体、编制方案、发布、运行维护、转让和终止等进行了自我评估。

一、价格指数行为主体

上海钢联是一家独立的第三方资讯机构，主要围绕价格、数据、快讯、分析、咨询、会务六大板块提供服务，公司名下有隆众资讯、钢银电子、百年建筑、中联钢等子公司，均不参与市场的买卖。

为保证 Mysteel 价格指数的独立性与专业性，上海钢联做出了如下努力。

（一）Mysteel 建立了完善的组织架构，培养专业的人员和设施

1.组织架构

Mysteel 组建了指数管理委员会，作为指数团队的最高管理机构，负责监督各品种价格指数的落地实施，下设指数工作组和指数研发部。指数工作组负责推动各品种价格指数方法论的实施，包括采集计算、留痕、发布等日常管理工作；指数研发部负责方法论研发、质量控制框架的设计搭建、团队培训及市场推广等落地实施工作。Mysteel 还成立了指数合规部，专门负责指数业务的合规工作。

2.专业人员

Mysteel 团队由指数负责人（经理）、指数高级研究员、指数初级研究员构成，指数高级研究员和指数负责人具有多年的行业经验。指数负责人和指数团队的高级研究员将定期审查指数团队的采价记录、价格留痕、指数计算等工作，并定期为指数团队进行方法论培训。

除此之外，Mysteel 还制定了《内部培训政策》，定期为指数组所有员工进行体系化的培训，培训的内容主要分为基础知识、规章制度和指数管理。

3.设施

Mysteel 建立了 OA 呼叫中心，每个通过电话采集的价格均可追根溯源，便于指数工作定编定岗、录音存档、规范采集。同时 Mysteel 拥有自己的网盘，所有价格指数相关的留痕都在网盘上进行，并根据职责设定相关查看和编辑的权限。

（二）Mysteel 建立了完备的内部控制流程以及投诉渠道和处理机制

1.内部控制流程

为保证价格指数的高质量运行，Mysteel 建立了从市场调研、样本库建立、数据采集、异常值剔除、验证、标准化入库、指数计算到指数发布一整套完备的内部控制流程。Mysteel 从各个环节入手进行内控，其中价格信息的采集与价格指数的计算都有专人负责，采集与计算相互分离；同时 Mysteel 实行产销分离，价格指数的销售也有专业的团队负责。

Mysteel 尽可能的排除利益冲突对价格指数产生影响，制定了《利益冲突政策》《利益冲突内部控制流程》。明确规定了指数团队人员的薪酬保持在相对较高的水平，绩效考核、职务晋升等不与价格指数的表现水平挂钩。

2.投诉渠道和处理机制

Mysteel 制定了《投诉政策》和《投诉处理机制》，详细说明了接收和调查有关 Mysteel 基准确定过程的投诉的程序，并设立了电话、邮件与信件 3 个官方投诉接收渠道，以保证投诉渠道畅通。

(1) 官方投诉电话：021-26093100，公布于所有价格表单下方；

(2) 官方投诉邮箱：complaints@mysteel.com；

(3) 官方投诉地址：上海市宝山区园丰路 68 号上海钢联电子商务股份有限公司，指数管理委员会收，200444，中国。

3.投诉处理情况

2023 年 Mysteel 再生精铅价格指数团队没有收到任何价格指数相关的投诉。

（三）Mysteel 价格信息来源稳定

Mysteel 严格控制来自外部的价格数据信息，制定了《提交者审核过程政策》《提交者行为准则》与《Mysteel 数据提交协议》。Mysteel 每年都会通过邮件发送以上资料为提交者进行培训并签订数据提交协议（邮件中明确，若 20 个工作日未收到提交者反对数据提交协议的声明，默认同意数据提交协议内容），明确规定了作为价格行为主体的 Mysteel 与提交者双方的义务与权力。

二、价格指数的编制方案

(一) 市场调研

价格指数的研发最重要的原则是遵循市场贸易习惯，Mysteel 研发的所有价格指数都是在基于市场的原则上进行研发梳理的。市场调研工作是价格指数研发工作最基础的一步，也是至关重要的一步。

市场调研工作主要从产业链地图梳理、年产能、产量、主流标准、进出口依存度、长协比例、现货倒手数、区域流动性、市场参与者、国内外主产地和主销地的规模、市场习惯的结算方式和贸易方式、现有客户的市场覆盖率和黏性、团队人员情况、方法论对标、合同调研等多方面展开，完成市场调研后才会进入到价格指数设计和编制的工作中，确保 Mysteel 研发的价格指数符合市场逻辑。

(二) 方法论

Mysteel 再生精铅价格指数方法论中对价格指数的编制背景和目的作出了详细的解释。方法论中价格指数内容介绍部分，针对 Mysteel 价格指数所反映的对象和范围作出明确界定，包括价格指数名称、样本数据类型、样本数据来源等。

Mysteel 再生精铅价格指数团队在设计价格指数时充分地考虑了相关市场的规模和流动性，在市场调研工作中详细的调研了产品基础情况，包括主流标准、区域流动性、市场参与者、现有客户的市场覆盖率和黏性等情况。Mysteel 将所有现货作为价格指数样本，其中代表规格品为再生精铅，符合 GB/T21181-2017 标准。 Mysteel 再生精铅价格指数团队收集的样本覆盖了大约 50%的市场，保证了足够的交易，以获得可观察的和透明的定价。

(三) 计算公式

Mysteel 针对市场上可能发生的各种情况制定了情形处理办法，明确各种情形下使用的数据形式、数据权重、优先级和计算公式，具体计算公式如下：

（1）采集到符合 Mysteel 样本要求的成交样本、询盘样本及报盘样本，计算公式：成交分数*权重+询盘分数*权重+报盘分数*权重；

（2）没有采集到符合 Mysteel 样本要求的成交样本，有询盘样本及报盘样本，计算公式：询盘分数*权重+报盘分数*权重；

（3）没有采集到符合 Mysteel 样本要求的成交样本、有可成交样本、询盘样本及报盘样本，计算公式：询盘分数*权重+报盘分数*权重+可成交分数*权重；

（4）没有采集到符合 Mysteel 样本要求的成交样本、询盘样本及报盘样本，有可参考的相关市场信息，计算公式：参照相关市场价格；

（5）发生灾难、恐怖袭击或不可抗拒事件时，没有采集到符合 Mysteel 样本要求的成交样本、询盘样本及报盘样本，没有可参考的相关市场信息，计算公式：参考前一交易日价格。

(四) 价格信息提交者约束措施

为保证价格信息真实性 ，Mysteel 严格控制来自外部的价格数据信息，制定了《提交者审核过程政策》《提交者行为准则》与《Mysteel 数据提交协议》。

(五) 主观判断条件

Mysteel 在价格指数编制过程中，针对主观判断的使用严格限定了合理条件及优先级来保证价格指数的准确性，使用主观判断的条件为当样本采集点无相关成交或样本停产而没有实际交易的情况，本年度未曾使用主观判断编制价格指数。

(六) 离群值处理措施

Mysteel 再生精铅价格指数团队建立了检测潜在异常值和可疑提交数据的措施，通过统计学方法来缓解异常值对价格指数的影响。Mysteel 再生精铅价格指数针对离群值的处理标准是 95%置信区间异常值排除法，对少数价格信息采集点数据占较大比例的情形的处理措施分为两种：一是新增价格指数时，遇到少数价格信息采集点数据占比较大，不能反映出该市场的实际情况，Mysteel 将做出不发布价格的决定；二是针对已有价格指数的情况，Mysteel 保留使用专家判断的权利，包括参考其他市场信息，如供需基本面和影响再生精铅价格的其他因素等。

(七) 方法论修订情况

Mysteel 再生精铅价格指数方法论已公开发布在指数页面，获取路径：https://index.mysteel.com/xpic/desktop.html。

2023 年，再生精铅价格指数团队未对再生精铅价格指数方法论作出任何调整。

2023 年，Mysteel 再生精铅价格指数没有新增。

三、价格指数发布

Mysteel 再生精铅价格指数将于样本收集并计算完成后，于每个工作日的 11:30 之前，通过 Mysteel 中文网站、以及手机 App 等途径发布。同时，Mysteel 作为价格指数行为主体，其基本情况及变动情况也将通过 https://about.mysteel.com/about/index.html 进行公布，市场客户可以通过 Mysteel 官方网站包括指数发布页面在内的任一页面尾部导航栏进行了解。

Mysteel 严格按照价格指数方法论进行数据的采集、计算和发布，为保证价格指数发布的透明性和完整性，指数发布后，再生精铅价格指数团队会在品种页面对进行脱敏处理后的当天计算所使用的询、报盘和成交数据进行披露。同时，Mysteel 再生精铅价格指数日报也会对当天计算所使用的数据类型及其占比、专家判断的使用情况等进行披露。

四、价格指数运行维护

(一) 价格信息提交制度

Mysteel 有完善的价格信息提交制度，严格控制来自外部的价格数据信息，制定了《提交者审核过程政策》《提交者行为准则》与《Mysteel 数据提交协议》，明确提交价格信息的人员、提交标准、提交时间和提交方式等。

Mysteel 价格信息提交方式包括 OA 呼叫中心、微信、邮件等，皆可满足价格信息追溯查询的需要。

Mysteel 再生精铅价格指数团队会对采集的所有价格信息进行核实，并有核实记录。

(二) 指数运行情况

Mysteel 如果发现已发布的价格指数有错误，无论是由提交错误还是计算错误引起的，Mysteel 将立即发出公告以提醒市场并修改错误的指数值。本年度 Mysteel 再生精铅价格指数团队发布的价格指数未出现错误情况。

(三) 信息归档

Mysteel 将价格信息相关的所有信息全部归档，所有文档存储在限制访问的安全可靠的云端存储盘（云盘）上，同时在公司内部的网盘中备份，保留书面记录至少五年，具体归档的信息包括：

（1）所有市场数据，提交的数据，关于基准确定的任何其他数据和信息；

（2）价格数据采集人员信息；

（3）行使的专家判断依据和结果；

（4）离群值或可以交易排除的记录。

(四) 内部控制

为保证价格指数完整性和可靠性，Mysteel 制定了内部控制流程，包括价格信息采集人员、指数计算人员和销售人员的隔离措施和监督机制，价格指数审核评估程序、授权发布程序，以及内部控制流程的定期审查和更新机制等。再生精铅价格的信息采集和指数计算均为不同人员，专人专岗，避免不当操作；审核人员一般由部门经理担任，具备最高的专业素养，价格发布前由审核人员审核完成后，再由专人进行指数发布，在价格尚未发布前，不会以任何形式将结果或相关信息泄露给无关人员。

五、价格指数转让和终止

(一) 价格指数转让

2023 年度 Mysteel 再生精铅价格指数无转让情况。

(二) 价格指数终止

Mysteel 制定了明确的停止和过渡政策和程序《指数终止和过渡政策》， 2023 年度 Mysteel 再生精铅价格指数无终止情况。

六、严重违规事项

Mysteel 再生精铅价格指数团队严格遵循《办法》进行价格指数的编制运行，不存在损害国家利益或社会公共利益、编造发布虚假价格指数、操纵价格指数、利用价格指数组织相关经营者达成价格垄断协议、伪造/编造归档文件/评估报告、不配合价格主管部门评估和合规性审查、与相关市场主体进行不当利益交换、价格指数行为主体及其实际控制人和高级管理人员参与价格指数所反映的商品和服务市场的交易或其他严重违反《办法》规定的其他行为。